

Reporting en date de 20/09/2024

CONSTRUCTION DE L'INDICE

• Objectifs de l'indice

L'indice Refinitiv Eurozone ESG Select Index est composé d'actions de la zone euro, sélectionnées en fonction de leurs pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

• Méthode de construction de l'indice

Il s'agit d'un indice des marchés actions de la zone euro, calculé, mis à jour et publié par Refinitiv qui présente les caractéristiques suivantes :

a) Parmi les 200 plus grandes capitalisations boursières de la zone Euro, sont exclues les entreprises les plus controversées selon une notation controversée obtenue par application de la méthodologie développée par Refinitiv, sur la base d'un cahier des charges établi par l'équipe de recherche ESG de Federal Finance Gestion.

b) Les entreprises restantes sont évaluées selon une notation « ESG » (Environnement, Social et Gouvernance) permettant de classer les entreprises selon l'impact environnemental de leurs activités, la qualité de leurs relations sociales (droit du travail, respect des droits de l'Homme, etc...) et la qualité de leur gouvernance. Les scores ESG sont calculés, mis à jour et publiés par Refinitiv. Les 50 sociétés les mieux notées sont intégrées dans l'indice. Par ailleurs, si plusieurs entreprises possèdent le même score ESG, elles seront toutes retenues au sein de l'indice, qui peut ainsi contenir plus de 50 valeurs.

c) L'indice pondère de façon équivalente l'ensemble de ses constituants. Ainsi, si l'indice contient 50 valeurs, chaque action représente 2% du poids global de l'indice à chaque date de revue trimestrielle, sans impact lié à la capitalisation boursière.

d) L'indice est calculé en réinvestissant les dividendes nets détachés par les actions qui le composent et en retranchant un montant forfaitaire de 5% par an. Si les dividendes distribués sont inférieurs (respectivement, supérieurs) au niveau du montant forfaitaire, la performance de l'indice en sera amoindrie (respectivement, améliorée) par rapport à un indice à dividendes non réinvestis.

EN RÉSUMÉ

TICKER BLOOMBERG

RFTREES Index

DATE DE LANCEMENT

25/11/2019

AGENT DE CALCUL

Refinitiv

UNIVERS DE RÉFÉRENCE

Actions zone euro

DEVISE

Euro

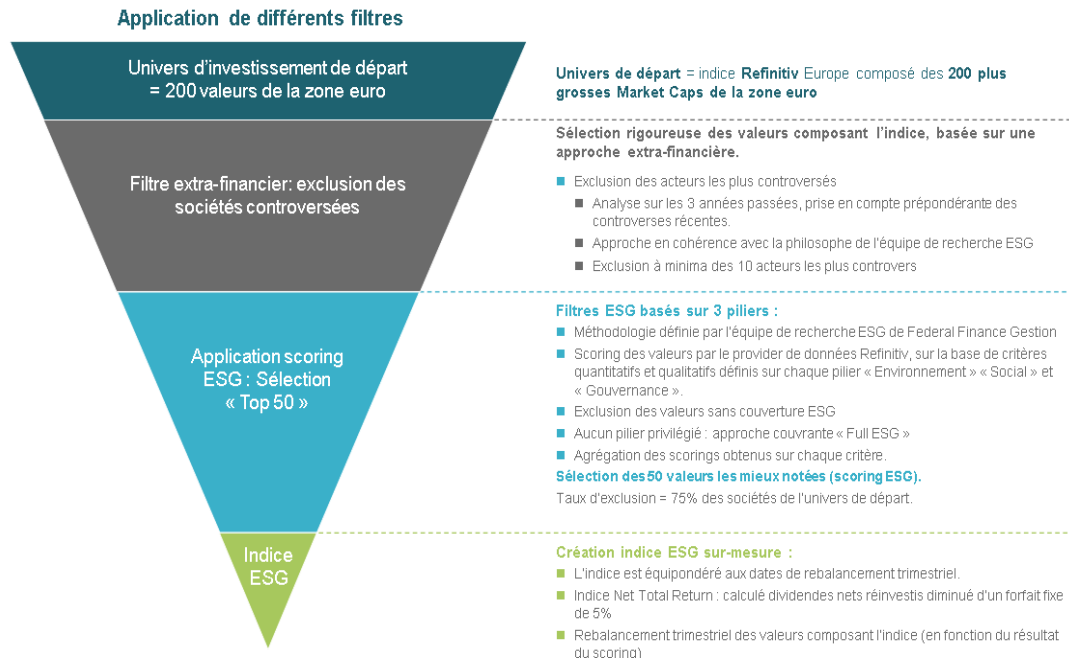
FRÉQUENCE REBALANCEMENT

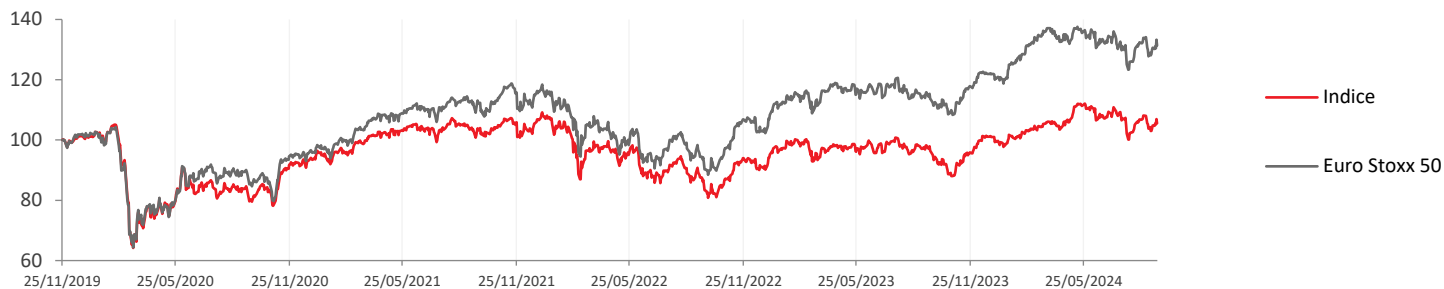
Trimestrielle

DIVIDENDE SYNTHÉTIQUE

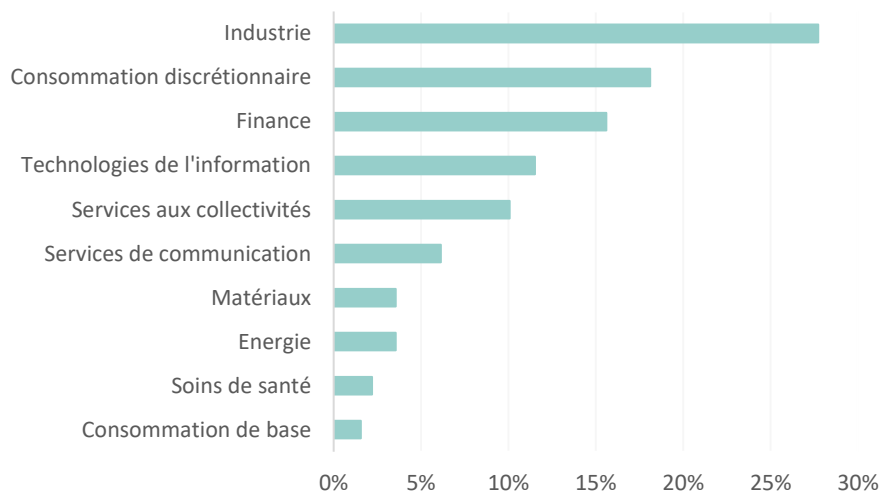
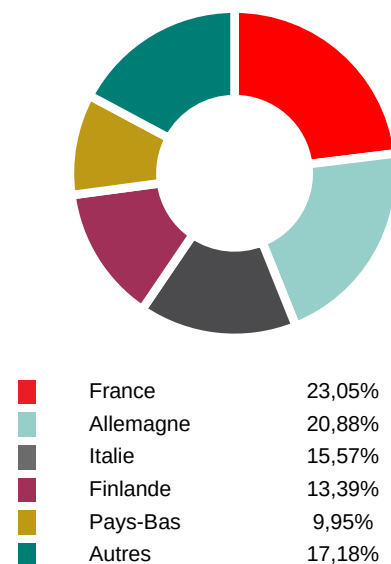
5%

PROCESSUS DE CRÉATION DE L'INDICE



COMPARAISON DES PERFORMANCES**INDICATEURS DE PERFORMANCES DU PORTEFEUILLE (DEPUIS 25/11/2019)**

	Rendement annualisé	Volatilité	Sharpe	Max drawdown
Indice	1,13%	19,84%	0,06	-38,95%
Euro Stoxx 50	5,83%	20,94%	0,28	-38,27%

RÉPARTITION SECTORIELLE**RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE****PRINCIPALES LIGNES DU PORTEFEUILLE**

Nom	Secteur	Pays	Poids
UCB SA	Soins de santé	Belgique	2,2%
SAMPO OYJ-A SHS	Finance	Finlande	2,2%
SAP SE	Technologies de l'information	Allemagne	2,2%
PRYSMIAN SPA	Industrie	Italie	2,2%
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	Services de communication	Allemagne	2,1%
GEA GROUP AG	Industrie	Allemagne	2,1%
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	Industrie	France	2,1%
INTESA SANPAOLO	Finance	Italie	2,1%
IBERDROLA SA	Services aux collectivités	Espagne	2,1%
NOKIA OYJ	Technologies de l'information	Finlande	2,1%

Sources du document : Bloomberg, Federal Finance Gestion et Refinitiv

Page 2/2

Données arrêtées au 20/09/2024